附件

原油期货TAS升贴水相关业务仿真交易指南

一、参与交易

帐号、密码、交易编码等使用上期能源仿真测试环境已设立的数据。

二、适用期货合约

sc2204、sc2205、sc2206、sc2207

三、交易时间

每周一至周五的开市集合竞价阶段，21:00 - 02:30（+1），09:00 - 10:15，10:30 - 11:30。

四、仿真参数

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **仿真交易参数值** |
| 适用品种 | 原油期货 |
| 适用期货合约 | 上市原油期货合约的前四行（若首行期货合约剩余交易日不足8天，则不挂牌对应TAS合约） |
| TAS代码 | sc2204TAS、sc2205TAS、sc2206TAS、sc2207TAS（注: sc2207TAS合约将在20220301上市） |
| 报价升贴水范围 | ±2元/桶，对应±20个最小价格变动单位（tick） |
| 交易单位 | 同适用期货合约（1000桶/手） |
| 报价单位 | 同适用期货合约（元/桶） |
| 最后交易日 | 适用期货合约最后交易日前第八个交易日 |
| 交易保证金 | 同适用期货合约 |
| 开仓手续费 | 20元/手 |
| 平历史仓手续费 | 20元/手 |
| 平今仓手续费 | 0元/手 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |
| 限价单最小下单量 | 1手 |

五、技术指引

**（一）仿真交易系统（通过证联网测试网接入）**

前端域名服务（以下简称FENS）地址为：

42.24.1.47、 42.24.1.48

使用FENS服务器获取交易前置机地址参数的TCP普通链路端口号为5901；使用FENS服务器获取行情前置机地址参数的TCP普通链路端口号为5903。

各会员单位和各行情转发单位的网络安全控制策略应开通对42.24.1.0/24网段上TCP端口为5901、5903、43005、43011的访问权限；及对42.24.1.0/24网段上TCP端口为80、443、7002的访问权限。确保上述网段及协议端口的通讯正常。

上期能源的一档行情主题号为5001，发布频率为每秒2笔。

**（二）仿真二代行情平台（通过证联网测试网接入）**

行情查询服务相参数：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 网络通道 | IP | TCP端口号 |
| 行情A路 | 42.24.1.147 | 43022 |
| 行情B路 | 42.24.1.148 | 43022 |

增量行情服务相关参数：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 产品 | 行情主题 | 网络通道 | 组地址 | 前置地址 | 端口 |
| 上期能源一档单边行情 | 5001 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 25001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 25001 |
| 上期能源五档单边行情 | 5000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 25000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 25000 |

**（三）仿真会员服务系统（通过证联网测试网接入）**

<http://42.24.1.245>

**（四）仿真会员结算文件下载API接口（通过证联网测试网接入）**

IP: 42.24.1.149，端口：443

开放时间段：交易日 15:00 - 21:00

测试用户和证书信息在仿真会服系统20210223的通知中。

**（五）期货市场监控中心仿真统一开户系统（通过证联网接入）**

如需新开客户，请通过以下地址申请。

（1）web方式的地址:

https://42.0.2.2:7002/test

（2）接口调用方式的地址

ssl://42.0.2.3:51002

**（六）期货市场监控中心盘后报送测试系统**

15.9.11.45（专线地址），报送服务器端口：9000

42.0.2.4（证联网地址），报送服务器端口：9000

**（七）仿真交易数据准备**

请提前做好技术系统的仿真交易准备。如需要更多资金，请联系上期能源另外申请。

**（八）注意事项**

本次仿真交易不涉及客户统一开户、交割、仓单业务、银行转账等相关业务。

**（九）要求**

会员/境外特参应填写《原油期货TAS升贴水相关业务仿真交易反馈表》（见附表），以电子邮件方式发送到信息科技一部tech@shfe.com.cn。

六、联系方式

技术咨询：021-20616345

产品咨询：021-20616126

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传 真：021-68400385

特此通知。

附表：原油期货TAS升贴水相关业务仿真交易反馈表

附表

原油期货TAS升贴水相关业务仿真交易反馈表

|  |
| --- |
| **会员/境外特参情况** |
| 公司名称 |  | 会员号/境外特参号 |  |
| 技术系统联系人 | 姓名： | 电话： |
| Email： |  |
| **技术系统情况** |
| 使用系统 | 金仕达□　　恒生□　　易盛□　　上期技术□　　自开发□ |
| 其他：（开发商名称）： |
| 报盘机IP地址 |  | 登录用户名 |  |
| **测试场景反馈** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 场景名称 | 参与角色 | 系统名称 | 功能点 | 测试场景 | 是否通过 |
| 日常交易 | 会员/境外特参 | 会员/境外特参系统、交易所交易系统 | 与交易所系统连接 | 1．确认会员/境外特参是否连接到交易所正常交易2．一代行情是否正常3．二代行情是否正常 |  |
| 会员/境外特参系统、交易所交易系统、终端厂商系统 | 查询合约、接收合约状态切换信息 | 查询 TAS合约正常接收,TAS 合约状态切换信息正常 |  |
| 会员/境外特参系统、终端厂商系统 | 投资者对 TAS合约报单、撤单 | 1．“价格”可以在涨跌停板范围内任意报价，可以为正，可以为0，可以为负；2．“报单价格条件”只支持“限价”；3．“有效期类型”仅支持“当日有效”，不支持“IOC”；验证投资者的各项资金和持仓计算准确性。保证金占用、冻结计算、盈亏计算、持仓计算等。请联系开发商确定 TAS 合约保证金、盈亏计算公式。4．10:30到11:30间仍可对TAS进行报单。 |  |
| 会员/境外特参系统、终端厂商系统 | 投资者对 TAS合约和适用期货合约进行平仓 | 1．TAS 报单能平适用期货合约的昨仓和今仓；2．TAS 报单能平 TAS 今仓；3．适用期货合约报单能平 TAS 今仓；平仓顺序：区分“平昨”、“平今”指令，区分昨仓和今仓，按成交编号先开先平，但不区分TAS持仓和适用期货合约持仓。 |  |
| 会员/境外特参系统、终端厂商系统 | 投资者对 TAS合约下套保单 | 支持 TAS合约下套保单。TAS 报单与适用期货合约共用套保额度。 |  |
| 会员/境外特参系统、交易所交易系统 | 对投资者进行实时风险监控 | 检查会员/境外特参下客户是否有异常交易情况；并提出预警。注：TAS 合约与适用期货合约在超仓、强平、异常交易监管等行为上合并进行风控，对投资者资金进行监控并进行追保、强平等操作。可进行对敲测试。 |  |
| 会员/境外特参系统、交易所交易系统 | 压力测试 | 进行程序化报单，验证会员/境外特参的交易、风控系统和交易所交易系统能正常工作。 |  |
| 日常结算 | 会员 | 会员系统 | 上期能源结算文件导入 | 结算文件导入成功，结算文件中包含TAS成交调整文件。结算文件可以从会服系统下载也可以通过API接口自动获取，两种方式均需测试。 |  |
| 会员系统 | 系统结算 | 结算流程正常1．TAS合约转换为适用期货合约参与结算；2．TAS合约手续费采用针对 TAS合约的设置；3．TAS合约保证金采用适用期货合约的保证金率设置；4．TAS成交价为成交调整文件中的成交价 |  |
| 会员系统 | 结算结果核对 | 核对结果正确：上期能源成交、资金、投资者持仓、会员持仓等核对正确 |  |
| 会员系统 | 报表 | 生成报表结果正确性； |  |
| 数据报送 | 会员 | 会员系统 | 报送数据生成/报送结果查询 | 报送文件正确性：1．成交明细（按 TAS 合约成交展示）；2．平仓明细（按 TAS 合约成交展示）；3．其他文件含有 TAS 的按适用期货合约显示；4．报送功能的回归测试（含其他期货/期权） |  |

**注：请会员/境外特参按每个席位填写此表，并在仿真交易结束（2022年3月18日）前通过**

**电子邮件方式，递交到信息科技一部，邮箱：****tech@shfe.com.cn** **。谢谢配合。**

填表日期： 填表人：